

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.146.216,55	5,02%	579	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.072.502,93	4,70%	194	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.162.946,78	9,47%	1.331	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.269.676,33	14,31%	108	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	263.190,01	1,15%	38	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	895.867,88	3,92%	39	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.633.230,44	11,53%	57	1,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.295.575,08	10,05%	5	22,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.963.866,17	8,60%	259	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.007.820,77	13,17%	385	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	699.085,47	3,06%		0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.499.248,53	6,56%	31	0,67%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	584.809,96	2,56%	61	7,07%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.347.178,78	5,90%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			22.841.215,68				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (maio / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	100,00%	0,00	0,00%	22.841.215,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	100,00%	7.651.342,59	33,50%	15.189.873,09
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.426.182,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	80,00%	6.087.863,41	26,65%	12.185.109,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	4.971.686,94	21,77%	1.880.677,76
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.568.243,14
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.198.334,00	9,62%	771.024,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	456.824,31
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.347.178,78	5,90%	-1.347.178,78
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	22.256.405,72	97,44%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	6.852.364,70
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.568.243,14
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	584.809,96	2,56%	2.841.372,39
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.142.060,78
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.142.060,78
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.142.060,78
Total	30,00%	80,00	584.809,96	2,56%	

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	1,35%	6,94%	3,57%	8,61%	16,94%	35,73%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,35%	-46,36%	-45,66%	-46,66%	-43,11%	-34,10%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,24%	6,58%	3,57%	8,31%	16,02%	-	1,65%	-	0,75%

Selic	1,11%	5,50%	3,36%	6,73%	14,00%	27,24%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	5,47%	3,35%	6,70%	14,00%	27,41%	0,20%	0,005%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,09%	5,35%	3,26%	6,56%	13,73%	26,67%	0,15%	0,004%	0,02%

IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	6,24%	3,42%	7,46%	14,54%	26,97%	0,20%	0,087%	0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	6,26%	3,42%	7,49%	14,65%	27,05%	0,20%	0,084%	0,49%

IMA-B 5	0,80%	7,82%	3,13%	10,11%	16,83%	31,29%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,20%	-	-	-	-	-	0,70%	1,201%	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,77%	-	3,11%	6,91%	13,30%	-	0,70%	0,495%	0,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,75%	7,84%	3,16%	10,14%	16,11%	-	0,20%	0,990%	3,69%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,74%	1,06%	1,47%	-6,74%	-3,03%	8,05%	0,70%	4,472%	13,01%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,52%	6,65%	2,62%	8,62%	11,01%	23,45%	0,70%	1,565%	4,06%

IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,47%	3,06%	9,58%	16,70%	31,05%	0,20%	1,279%	3,11%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,18%	13,82%	9,29%	15,50%	13,47%	28,57%	0,20%	3,555%	9,81%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-10,09%	11,82%	13,27%	7,43%	-8,13%	-5,40%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	-5,27%	6,73%	9,07%	3,84%	-8,86%	-11,00%	1,90%	8,713%	18,47%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (maio / 2016)

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	11.947.096,64	52,30%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.309.163,33	14,49%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.506.236,67	10,97%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.295.575,08	10,05%
CM Capital Markets DTVM	1.499.248,53	6,56%
Orla DTVM	699.085,47	3,06%
Única Administradora	584.809,96	2,56%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.435.042,19	32,55%
CDI	4.971.686,94	21,77%
IMA-B	3.269.676,33	14,31%
IRF-M 1	3.235.449,71	14,16%
FIDC	2.198.334,00	9,62%
IDKA IPCA 2A	1.146.216,55	5,02%
AÇÕES - LIVRES	584.809,96	2,56%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	19.199.865,09	0,00	40.000,00	19.433.929,60	274.064,51	1,43%	1,74%	82,06%	0,96%
Fevereiro	19.433.929,60	1.596.090,50	0,00	21.236.239,65	206.219,55	0,98%	1,34%	72,95%	1,37%
Março	21.236.239,65	679.109,21	6.000,00	21.820.219,71	-89.129,15	-0,41%	0,94%	-43,18%	2,28%
Abril	21.820.219,71	558.000,00	0,00	22.284.367,37	-93.852,34	-0,42%	1,08%	-38,96%	1,42%
Mai	22.284.367,37	422.000,00	0,00	22.841.215,68	134.848,31	0,59%	1,27%	46,74%	1,39%
Acumulado no ano					432.150,88	2,18%	6,54%	33,37%	

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	689.281,23	0,00	0,00	699.085,47	9.804,24	1,42%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.480.842,39	0,00	0,00	1.499.248,53	18.406,14	1,24%	-	1,24%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	260.076,68	0,00	0,00	263.190,01	3.113,33	1,20%	1,20%	1,20%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.974.503,55	0,00	0,00	3.007.820,77	33.317,22	1,12%	0,00%	1,12%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.942.762,33	0,00	0,00	1.963.866,17	21.103,84	1,09%	0,00%	1,09%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.061.279,92	0,00	0,00	1.072.502,93	11.223,01	1,06%	0,09%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.140.415,64	0,00	0,00	2.162.946,78	22.531,14	1,05%	0,08%	1,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.137.173,21	0,00	0,00	1.146.216,55	9.043,34	0,80%	1,28%	0,80%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.278.052,73	0,00	0,00	2.295.575,08	17.522,35	0,77%	0,50%	0,77%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.613.734,50	0,00	0,00	2.633.230,44	19.495,94	0,75%	0,99%	0,75%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	889.256,80	0,00	0,00	895.867,88	6.611,08	0,74%	4,47%	0,74%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.340.210,18	0,00	0,00	1.347.178,78	6.968,60	0,52%	1,56%	0,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.859.443,88	422.000,00	0,00	3.269.676,33	-11.767,55	-0,36%	3,56%	-0,18%
Total Renda Fixa					167.372,68	0,76%	1,17%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	617.334,33	0,00	0,00	584.809,96	-32.524,37	-5,27%	8,71%	-5,27%
Total Renda Variável					-32.524,37	-5,27%	8,71%	